

RAD1507 – Estatística Aplicada à Administração I – Diurno

Prof. Dr. Evandro Marcos Saidel Ribeiro

E-mail: esaidel@usp.br, RAD-FEARP-USP

CRONOGRAMA 2017

Sala 2

Aulas: Quarta: 10h00-11h40 Sexta: 08h00-09h40

Data	Dia	Conteúdo	Entrega
08/mar	4 ^a	Apresentação da disciplina; Revisão; Softwares	
10/mar	6 ^a	Revisão: Introdução à Estatística - Excel; R; KNIME	
15/mar	4 ^a	Teste de hipótese - uma amostra	Lista 01
17/mar	6 ^a	Teste de hipótese - uma amostra	Lista 02
22/mar	4 ^a	Teste de hipótese - duas amostras	
24/mar	6 ^a	Teste de hipótese - duas amostras	Lista 03
29/mar	4 ^a	Teste de hipótese - várias amostras (ANOVA)	
31/mar	6 ^a	Teste de hipótese - várias amostras (ANOVA)	Lista 04
05/abr	4 ^a	Preparação da apresentação de trabalho e Revisão	
07/abr	6 ^a	Exercícios de Revisão	Lista 05
12/abr	4 ^a	Semana Santa. Não haverá aula	
14/abr	6 ^a	Semana Santa. Não haverá aula	
19/abr	4 ^a	Trabalho 1 – Teste de Hipóteses	Apresentação 1
21/abr	6 ^a	Tidudentes. Não haverá aula	
26/abr	4 ^a	Exercícios de Revisão	
28/abr	6 ^a	Exercícios de Revisão e Correlação/Covariância	
03/mai	4 ^a	Covariância: Análise de Portfólio, Correlação Linear	Listas 06 e 07
05/mai	6 ^a	1 ^a Prova – Testes de Hipóteses	
10/mai	4 ^a	Regressão Linear Simples (RLS)	
12/mai	6 ^a	Regressão Linear Simples (RLS)	Lista 08
17/mai	4 ^a	RLS: CAPM (Capital Asset Pricing Model)	
19/mai	6 ^a	Regressão Linear Múltipla	Lista 09
24/mai	4 ^a	Regressão Linear Múltipla - Excel e R	
26/mai	6 ^a	Regressão Linear Múltipla - Excel e R	Lista 10
31/mai	4 ^a	Séries Temporais - Introdução	
02/jun	6 ^a	Séries Temporais - Introdução	
07/jun	4 ^a	Preparação p/ Trabalho 2	
09/jun	6 ^a	Preparação p/ Trabalho 2 - Simulação	Lista 11
14/jun	4 ^a	Preparação p/ Trabalho 2 - Otimização	Lista 12
16/jun	6 ^a	Corpus Christi - recesso. Não haverá aula.	
21/jun	4 ^a	Trabalho 2 – Correl. / Regressão / Séries Temporais	Apresentação 2
23/jun	6 ^a	Resumo: Covariância, Correlação e Regressão	Lista 13
28/jun	4 ^a	2 ^a Prova – Covariância, Correlação e Regressão	Lista 14
30/jun	6 ^a	Correção da prova	
05/jul	4 ^a	Prova Sub (todo conteúdo, substitui uma prova)	
07/jul	6 ^a	Entregas em atraso - prazo máximo	

CRITÉRIOS PARA AVALIAÇÃO

A avaliação será feita através de duas provas, duas apresentações e 14 listas de exercícios.

A média final (MF) de cada aluno será determinada por

$$MF = 0,7 P + 0,2 L + 0,1 A$$

Sendo P, L e T valores entre zero e dez dados por:

P = Média aritmética entre a nota obtida na Prova 1 e a nota obtida na Prova 2;

L = Média aritmética obtida em 14 Listas;

A = Média aritmética obtida em duas Apresentações.

Provas:

As Provas estão marcadas para as seguintes datas: **P₁: 28 de abril e P₂: 28 de junho.**

- Será permitido consulta em material próprio: impresso ou escrito em papel.

- Não é permitido utilizar celular ou *tablet* na prova.

Apresentações:

As apresentações deverão ser postadas no STOA da disciplina em arquivo PowerPoint ou pdf.

- A nota máxima em cada Apresentação é 10,0 (dez).

- A nota de cada apresentação é definida por $A_i = 0,3 C + 0,7 Ap$, sendo C a nota do Conteúdo e Ap a nota da Apresentação Oral ou Apresentação de Pôster.

- Quem não fizer a apresentação no dia agendado poderá fazer posteriormente, até 7/Jul. Neste caso a nota máxima A_i será 6,0, ou seja: $A_i = 0,3 C + 0,3 Ap$. Note que se a apresentação for postada no STOA mas não for apresentada, a nota máxima será 3,0.

Listas de exercícios:

- Cada Lista de exercícios, tem a nota máxima igual a 10,0.

- As Listas (respostas) deverão ser entregues no site STOA da disciplina nos dias apontados no cronograma até o horário estipulado no site STOA da disciplina, ou então até o final da aula do dia indicado no Cronograma.

- A nota máxima para Listas entregues fora do prazo é igual a 3,0. O controle do atraso é feito com base no registro de entrega no STOA da disciplina.

Controle de frequência:

O controle de frequência será feito em cada aula, na forma de chamada ou com assinatura. O controle parcial será apresentado a cada aula em planilha Excel. A frequência final será igual ao número de presenças dividido pelo número total de dias de aula. Para este semestre de 2017 o número de dias de aula é igual a 32. Atingindo 11 faltas a frequência final resulta em 65,625%.

O número máximo de faltas permitido neste semestre é igual a 10 (dez faltas).

O número máximo individual de faltas até o final do semestre será atualizado a cada chamada e apresentado em cada aula, em planilha Excel. O aluno que preferir que suas informações de frequências não sejam apresentadas durante a chamada deve fazer esta solicitação por e-mail.

Atenção: Atestado médico não remove faltas. Procure a secretaria de graduação para informações sobre esta questão.

BIBLIOGRAFIA

Nesta disciplina serão utilizados materiais contidos nos seguintes livros:

● LEVINE, David M.; STEPHAN, David F.; KREHBIEL, Timothy C.; BERENSON, Mark L. *Estatística: Teoria e aplicações usando Microsoft® Excel em português*, 6^a ed. Rio de Janeiro: LTC, 2012.

● TRIOLA, M.F. *Introdução à Estatística*, 10^a ed. Rio de Janeiro: LTC, 2008.

MALHOTRA, N. K., *Pesquisa de Marketing*, 3^a ed., Bookman

STEVENSON, W. J. *Estatística Aplicada à Administração*. São Paulo: Harbra, 1986.

ANDERSON, D. R.; **SWEENEY**, D. J. ; **WILLIAMS**, T. A. *Estatística Aplicada à Administração e Economia*. 2^a ed. São Paulo: Cengage Learning, 2007.

CORRAR, L. J.; Paulo, E.; Dias Filho, J. M.; *Análise Multivariada - Para os cursos de Administração, Ciências Contábeis e Economia*, 1^a ed., Atlas, 2007.

FÁVERO, Luiz P.; **BELFIORE**, Patrícia; **DA SILVA**, Fabiana L.; **CHAN**, Betty L. *Análise de Dados: Modelagem multivariada para tomada de decisões*, Rio de Janeiro: Elsevier, 2009.

JOHNSON, Richard A.; **WICHERN**, Dean W. *Applied Multivariate Statistical Analysis*, 5th Ed. London, 2002.

MATERIAL PARA ESTUDO

Os slides e demais arquivos apresentados nas aulas serão disponibilizados no site STOA. A seguir são informados os capítulos e páginas dos principais livros da bibliografia relacionados ao conteúdo ministrado nas aulas. A referência para **capítulo é feita em negrito**. Alguns tópicos específicos poderão ser encontrados apenas nos slides de aula ou no resumo da disciplina, estes casos estão indicados por "Slides/Resumo".

Conteúdo	ANDERSON	STEVENSON	LEVINE	TRIOLA
Revisão	1-8	1-8	1-8	1-7
Teste de Hipótese (TH) - uma amostra	9 , 309-351	9-10 , 231-240	9	8 , 304-359
TH - duas amostras	10 , 353-372	10 , 240-250	10	9 , 360-407
TH - várias amostras: ANOVA	10 , 372-397	11	11	12
Teste de Hipótese: Revisão	9-10	9-11	9-11	8, 9 e 12
Prova 1 (Listas 1-7, Resumo)	9-10	9-11	9-11	8, 9 e 12
Covariância e Correlação (Pearson)	3 , 98-106	14 , 367-382	13 , 480-533	10 , 408-428
Matriz de covariância e de correlação	Slides/Resumo	Slides/Resumo	Slides/Resumo	Slides/Resumo
Risco de uma carteira	Slides/Resumo	Slides/Resumo	Slides/Resumo	Slides/Resumo
Regressão linear simples	12	14 , 341-365	13	10 , 429-449
Modelo CAPM	Slides/Resumo	Slides/Resumo	Slides/Resumo	Slides/Resumo
Regressão linear múltipla	13	14 , 365-367	14	10 , 450-467
Prova 2 (Listas 8-14, Resumo)	3, 12 e 13	14	13-14	10

BASES DE DADOS PARA TRABALHOS Para realizar os Trabalhos T1 e T2 considere as seguintes bases:

Base 1: Base de arquivos extraídos de exemplos de livros didáticos. **Utilizar em T₁**.

Base de dados	Livro	Página
01 - Financeira.xls	Fávero	464
02 - MunicipiosSP.xls	Fávero	263
03 - Imoveis.xls	Fávero	386, 387
04 - Porte.xls	Corrar	10 a 50
05 - Setores.xls	Corrar	51 a 59
06 - AssessoriaTI.xls	Corrar	66
07 - MercadoSeguradoras.xls	Corrar	96
08 - Alunos.pdf	Corrar	125
09 - Ferias.pdf	Malhotra	528
10 - CremeDental.pdf	Malhotra	551 *
11 - DomesticoCompras.pdf	Malhotra	566 *
12 - AtitudeCompras.pdf	Malhotra	575 *

* Para estas bases o aluno deverá obter mais observações aplicando o questionário correspondente (para outros alunos) de maneira a pelo menos dobrar o número de respondentes da base original.

Base 2: DadosBovespa.xlsx – Base de cotação de preços de ativos. **Utilizar em T₂**.

Alternativa para Bases: O aluno poderá utilizar outras bases de dados, desde que seja feita a solicitação com antecedência de duas semanas da apresentação e que a solicitação seja aprovada.